

2020年8月21日

各 位

委託会社名 大和アセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名 代表取締役社長 松下 浩一
担当者の役職氏名 営業企画部 岩崎 論
(連絡先 03-5555-4821)

2020年7月期（2020年1月11日～2020年7月10日）決算短信

大和アセットマネジメント株式会社を管理会社として上場するETF銘柄について、以下のとおり2020年7月期（2020年1月11日～2020年7月10日）決算短信をご報告します。

記

上場ETF銘柄（6銘柄）

銘柄名	銘柄コード	上場取引所
ダイワ上場投信－MSCI 日本株人材設備投資指数	1479	東
ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials	1585	東
ダイワ上場投信－J P X日経400	1599	東
ダイワ上場投信－MSCI 日本株女性活躍指数（WIN）	1652	東
ダイワ上場投信－MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数	1653	東
ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index	1654	東

*各銘柄の決算短信につきましては、次ページ以降をご参照ください。
なお、各銘柄名をクリックしていただくと、各銘柄の決算短信が表示されます。

以上

2020年7月期（2020年1月11日～2020年7月10日）決算短信

2020年8月21日

ファンド名 ダイワ上場投信－MSCI日本株人材設備投資指数 上場取引所 東証
 コード番号 1479
 連動対象指標 MSCI日本株人材設備投資指数
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和アセットマネジメント株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 問合せ先責任者 (役職名)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

有価証券報告書提出予定日 2020年10月 2日
 分配金支払開始日 2020年 8月18日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月期の運用状況（2020年1月11日～2020年7月10日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2020年 7月期	40,008	(98.4)	637	(1.6)	40,646	(100.0)
2020年 1月期	48,981	(98.5)	732	(1.5)	49,714	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年 7月期	2,381	—	238	2,143
2020年 1月期	2,917	—	535	2,381

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年 7月期	49,339	8,693	40,646	18,964.5
2020年 1月期	62,476	12,762	49,714	20,872.9

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年 7月期	248
2020年 1月期	230

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

Ⅱ 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第8期	第9期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,306,443,447	9,176,844,558
株式 ※2※3	48,981,695,900	40,008,521,360
派生商品評価勘定	5,520,744	—
未収入金	69,015,630	—
未収配当金	86,278,850	59,082,750
未収利息	141,137	188,162
前払金	—	47,156,675
その他未収収益 ※4	12,238,720	11,900,481
差入委託証拠金	15,456,000	36,064,000
流動資産合計	62,476,790,428	49,339,757,986
資産合計	62,476,790,428	49,339,757,986
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	30,077,415
前受金	8,208,264	—
未払金	—	29,799,480
未払収益分配金	547,805,720	531,534,184
未払受託者報酬	9,378,600	8,695,361
未払委託者報酬	32,842,811	29,805,073
受入担保金	12,162,490,179	8,061,928,402
その他未払費用	1,624,874	1,560,691
流動負債合計	12,762,350,448	8,693,400,606
負債合計	12,762,350,448	8,693,400,606
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	38,334,491,580	34,496,139,885
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,379,948,400	6,150,217,495
（分配準備積立金）	2,172,164	795,437
元本等合計	49,714,439,980	40,646,357,380
純資産合計	49,714,439,980	40,646,357,380
負債純資産合計	62,476,790,428	49,339,757,986

(2) 損益及び剰余金計算書

	第8期	第9期
	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	564,626,200	548,071,244
受取利息	4,156,565	4,268,708
有価証券売買等損益	5,018,575,021	△4,837,444,923
派生商品取引等損益	108,239,902	△16,016,250
その他収益 ※1	34,177,792	28,501,892
営業収益合計	5,729,775,480	△4,272,619,329
営業費用		
支払利息	2,163,239	1,623,978
受託者報酬	9,378,600	8,695,361
委託者報酬	32,842,811	29,805,073
その他費用 ※2	11,475,428	10,559,975
営業費用合計	55,860,078	50,684,387
営業利益又は営業損失 (△)	5,673,915,402	△4,323,303,716
経常利益又は経常損失 (△)	5,673,915,402	△4,323,303,716
当期純利益又は当期純損失 (△)	5,673,915,402	△4,323,303,716
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	7,072,001,043	11,379,948,400
剰余金減少額又は欠損金増加額	818,162,325	374,893,005
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	818,162,325	374,893,005
分配金 ※3	547,805,720	531,534,184
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	11,379,948,400	6,150,217,495

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 9 期	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 8 期	第 9 期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	46,951,191,255 円	38,334,491,580 円
期中追加設定元本額	－円	－円
期中一部交換元本額	8,616,699,675 円	3,838,351,695 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,381,764 口	2,143,283 口

3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 11,870,817,410円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,583,385,750円
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 76,610,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 65,680,000円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分12,122,900円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分11,765,200円が含まれております。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第8期	第9期
	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
1. ※1 その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額30,483,900円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額25,115,700円が含まれております。
2. ※2 その他費用	主に、対象指数の商標の使用料であります。	主に、対象指数の商標の使用料であります。
3. ※3 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(600,797,318円)及び分配準備積立金(2,877,405円)の合計額から、経費(53,696,839円)を控除して計算される分配対象額は549,977,884円(10口当たり2,309円)であり、うち547,805,720円(10口当たり2,300円)を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(579,217,866円)及び分配準備積立金(2,172,164円)の合計額から、経費(49,060,409円)を控除して計算される分配対象額は532,329,621円(10口当たり2,483円)であり、うち531,534,184円(10口当たり2,480円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 9 期 自 2020 年 1 月 11 日 至 2020 年 7 月 10 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 9 期 2020 年 7 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

	(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
--	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 8 期 2020年1月10日現在	第 9 期 2020年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	4,979,940,771	△3,261,123,239
合計	4,979,940,771	△3,261,123,239

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第 8 期 2020年1月10日現在				第 9 期 2020年7月10日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	725,083,336	—	730,656,000	5,572,664	668,266,425	—	638,239,500	△30,026,925
合計	725,083,336	—	730,656,000	5,572,664	668,266,425	—	638,239,500	△30,026,925

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

第9期 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第8期 2020年1月10日現在	第9期 2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	20,872.9円	18,964.5円
（10口当たり純資産額）	（208,729円）	（189,645円）

2020年7月期（2020年1月11日～2020年7月10日）決算短信

2020年8月21日

ファンド名 ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials 上場取引所 東証
 コード番号 1585
 連動対象指標 TOPIX Ex-Financials
 主要投資資産 株式
 売買単位 10口
 管理会社 大和アセットマネジメント株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 問合せ先責任者 (役職名)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

有価証券報告書提出予定日 2020年10月 2日
 分配金支払開始日 2020年 8月18日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月期の運用状況（2020年1月11日～2020年7月10日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2020年 7月期	10,846	(99.9)	13	(0.1)	10,859	(100.0)
2020年 1月期	29,493	(99.9)	30	(0.1)	29,524	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年 7月期	21,943	1,949	14,922	8,969
2020年 1月期	22,039	6,815	6,911	21,943

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年 7月期	10,980	121	10,859	12,106.7
2020年 1月期	29,899	375	29,524	13,454.7

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2020年 7月期	113
2020年 1月期	156

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

Ⅱ 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第13期	第14期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	346,311,408	118,082,371
株式	29,493,240,421	10,846,064,770
未収入金	8,797,800	—
未収配当金	50,755,286	16,779,656
流動資産合計	29,899,104,915	10,980,926,797
資産合計	29,899,104,915	10,980,926,797
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	342,315,402	101,358,796
未払受託者報酬	8,048,475	3,973,770
未払委託者報酬	20,926,114	10,331,882
その他未払費用	3,794,473	5,764,589
流動負債合計	375,084,464	121,429,037
負債合計	375,084,464	121,429,037
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	21,701,918,755	8,871,137,145
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	7,822,101,696	1,988,360,615
(分配準備積立金)	623,504	152,338
元本等合計	29,524,020,451	10,859,497,760
純資産合計	29,524,020,451	10,859,497,760
負債純資産合計	29,899,104,915	10,980,926,797

(2) 損益及び剰余金計算書

	第13期	第14期
	自2019年7月11日 至2020年1月10日	自2020年1月11日 至2020年7月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	376,091,488	117,944,733
受取利息	130	159
有価証券売買等損益	3,390,265,093	△2,455,891,197
その他収益	222,921	42,527
営業収益合計	3,766,579,632	△2,337,903,778
営業費用		
支払利息	37,986	12,486
受託者報酬	8,048,475	3,973,770
委託者報酬	20,926,114	10,331,882
その他費用	5,643,613	2,781,651
営業費用合計	34,656,188	17,099,789
営業利益又は営業損失(△)	3,731,923,444	△2,355,003,567
経常利益又は経常損失(△)	3,731,923,444	△2,355,003,567
当期純利益又は当期純損失(△)	3,731,923,444	△2,355,003,567
期首剰余金又は期首欠損金(△)	5,028,456,133	7,822,101,696
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,157,372,314	433,710,462
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	1,157,372,314	433,710,462
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,753,334,793	3,811,089,180
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,753,334,793	3,811,089,180
分配金 ※1	342,315,402	101,358,796
期末剰余金又は期末欠損金(△)	7,822,101,696	1,988,360,615

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 14 期	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 13 期	第 14 期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	21,797,043,742 円	21,701,918,755 円
期中追加設定元本額	6,740,717,410 円	1,927,699,460 円
期中一部交換元本額	6,835,842,397 円	14,758,481,070 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	21,943,295 口	8,969,805 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 13 期	第 14 期
	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(376,276,553円)及び分配準備積立金(1,280,555円)の合計額から、経費(34,618,202円)を控除して計算される分配対象額は342,938,906円(100口当たり1,562円)であり、うち342,315,402円(100口当たり1,560円)を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(117,974,933円)及び分配準備積立金(623,504円)の合計額から、経費(17,087,303円)を控除して計算される分配対象額は101,511,134円(100口当たり1,131円)であり、うち101,358,796円(100口当たり1,130円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 14 期 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	--

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 14 期
	2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 13 期	第 14 期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	3,143,956,109	△939,954,525
合計	3,143,956,109	△939,954,525

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第 13 期	第 14 期
2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 14 期
自 2020年1月11日
至 2020年7月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第13期 2020年1月10日現在	第14期 2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	1,345.47円	1,210.67円
(100口当たり純資産額)	(134,547円)	(121,067円)

2020年7月期（2020年1月11日～2020年7月10日）決算短信

2020年8月21日

ファンド名 ダイワ上場投信－JPX日経400 上場取引所 東証
 コード番号 1599
 連動対象指標 JPX日経インデックス400
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 大和アセットマネジメント株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 問合せ先責任者 (役職名)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

有価証券報告書提出予定日 2020年10月 2日
 分配金支払開始日 2020年 8月18日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月期の運用状況（2020年1月11日～2020年7月10日）

(1)資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2020年 7月期	239,704	(99.7)	795	(0.3)	240,499	(100.0)
2020年 1月期	258,902	(99.5)	1,373	(0.5)	260,275	(100.0)

(2)設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年 7月期	16,583	1,885	1,334	17,135
2020年 1月期	15,491	1,390	297	16,583

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年 7月期	309,951	69,452	240,499	14,035.5
2020年 1月期	311,096	50,820	260,275	15,694.5

(4)分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年 7月期	167
2020年 1月期	152

(注)分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

Ⅱ 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第 12 期	第 13 期
	2020 年 1 月 10 日現在	2020 年 7 月 10 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	51,670,028,355	69,603,049,791
株式 ※2※3	258,902,624,500	239,704,281,800
派生商品評価勘定	11,176,035	—
未収入金	25,817,050	—
未収配当金	332,385,000	298,290,813
未収利息	914,100	1,624,223
前払金	—	133,871,520
その他未収収益 ※4	103,003,964	122,691,261
差入委託証拠金	50,460,000	87,670,000
流動資産合計	311,096,409,004	309,951,479,408
資産合計	311,096,409,004	309,951,479,408
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	38,684,809
前受金	28,110,345	—
未払金	—	139,446,781
未払収益分配金	2,520,750,216	2,861,554,185
未払受託者報酬	75,362,026	77,816,638
未払委託者報酬	179,809,807	182,304,836
受入担保金	47,936,710,636	66,120,994,883
その他未払費用	79,854,739	31,230,443
流動負債合計	50,820,597,769	69,452,032,575
負債合計	50,820,597,769	69,452,032,575
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	174,661,455,756	180,466,399,260
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	85,614,355,479	60,033,047,573
(分配準備積立金)	15,500,223	4,622,127
元本等合計	260,275,811,235	240,499,446,833
純資産合計	260,275,811,235	240,499,446,833
負債純資産合計	311,096,409,004	309,951,479,408

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 12 期	第 13 期
	自 2019 年 7 月 11 日 至 2020 年 1 月 10 日	自 2020 年 1 月 11 日 至 2020 年 7 月 10 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	2,599,117,195	2,903,814,994
受取利息	21,748,351	28,949,427
有価証券売買等損益	25,416,858,291	△27,024,645,115
派生商品取引等損益	299,612,356	104,739,355
その他収益 ※1	233,957,999	242,321,139
営業収益合計	28,571,294,192	△23,744,820,200
営業費用		
支払利息	10,567,752	10,758,012
受託者報酬	75,362,026	77,816,638
委託者報酬	179,809,807	182,304,836
その他費用	53,413,885	53,529,985
営業費用合計	319,153,470	324,409,471
営業利益又は営業損失 (△)	28,252,140,722	△24,069,229,671
経常利益又は経常損失 (△)	28,252,140,722	△24,069,229,671
当期純利益又は当期純損失 (△)	28,252,140,722	△24,069,229,671
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	55,654,508,607	85,614,355,479
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,461,299,824	6,222,279,650
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	5,461,299,824	6,222,279,650
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,232,843,458	4,872,803,700
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,232,843,458	4,872,803,700
分配金 ※2	2,520,750,216	2,861,554,185
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	85,614,355,479	60,033,047,573

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 13 期	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 12 期	第 13 期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	163,154,687,560 円	174,661,455,756 円
期中追加設定元本額	14,639,574,788 円	19,862,477,844 円
期中一部交換元本額	3,132,806,592 円	14,057,534,340 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	16,583,883 口	17,135,055 口

3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 46,838,641,720 円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 62,487,667,760 円
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 88,599,500 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 75,516,000 円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分 101,796,900 円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分 121,330,200 円が含まれております。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 12 期	第 13 期
	自 2019 年 7 月 11 日 至 2020 年 1 月 10 日	自 2020 年 1 月 11 日 至 2020 年 7 月 10 日
1. ※1 その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額 206,906,979 円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額 214,182,446 円が含まれております。
2. ※2 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (2,844,255,793 円) 及び分配準備積立金(580,364 円)の合計額から、経費(308,585,718 円)を控除して計算される分配対象額は 2,536,250,439 円(10 口当たり 1,529 円)であり、うち 2,520,750,216 円(10 口当たり 1,520 円)を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (3,164,327,548 円) 及び分配準備積立金(15,500,223 円)の合計額から、経費(313,651,459 円)を控除して計算される分配対象額は 2,866,176,312 円(10 口当たり 1,672 円)であり、うち 2,861,554,185 円(10 口当たり 1,670 円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 13 期 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 13 期 2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

	<p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
--	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 12 期 2020年1月10日現在	第 13 期 2020年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	25,592,260,851	△24,895,220,969
合計	25,592,260,851	△24,895,220,969

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第 12 期 2020年1月10日現在				第 13 期 2020年7月10日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,349,419,275	－	1,360,692,000	11,272,725	840,939,839	－	802,318,500	△38,621,339
合計	1,349,419,275	－	1,360,692,000	11,272,725	840,939,839	－	802,318,500	△38,621,339

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 13 期 自 2020 年 1 月 11 日 至 2020 年 7 月 10 日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

	第 12 期 2020 年 1 月 10 日現在	第 13 期 2020 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	15,694.5 円	14,035.5 円
(10 口当たり純資産額)	(156,945 円)	(140,355 円)

2020年7月期（2020年1月11日～2020年7月10日）決算短信

2020年8月21日

ファンド名 ダイワ上場投信－MSCI日本株女性活躍指数（WIN） 上場取引所 東証
 コード番号 1652
 連動対象指標 MSCI日本株女性活躍指数
 主要投資資産 株式
 売買単位 10口
 管理会社 大和アセットマネジメント株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 問合せ先責任者 (役職名)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

有価証券報告書提出予定日 2020年10月 2日
 分配金支払開始日 2020年 8月18日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月期の運用状況（2020年1月11日～2020年7月10日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2020年 7月期	1,178	(99.4)	7	(0.6)	1,185	(100.0)
2020年 1月期	1,294	(99.5)	6	(0.5)	1,301	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年 7月期	609	-	-	609
2020年 1月期	559	49	-	609

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×10
	百万円	百万円	百万円	円
2020年 7月期	1,201	16	1,185	19,457.1
2020年 1月期	1,313	12	1,301	21,355.1

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2020年 7月期	230
2020年 1月期	184

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

II 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第5期	第6期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,231,987	20,765,744
株式 ※3	1,294,143,320	1,178,009,520
派生商品評価勘定	57,560	—
未収入金	1,122,460	—
未収配当金	1,879,312	1,974,875
前払金	—	793,000
流動資産合計	1,313,434,639	1,201,543,139
資産合計	1,313,434,639	1,201,543,139
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	223,550
前受金	137,500	—
未払金	—	814,920
未払収益分配金	11,210,365	14,012,957
未払受託者報酬	184,830	192,988
未払委託者報酬	739,492	772,079
その他未払費用	84,649	84,435
流動負債合計	12,356,836	16,100,929
負債合計	12,356,836	16,100,929
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,215,471,705	1,215,471,705
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	85,606,098	△30,029,495
（分配準備積立金）	47,365	27,783
元本等合計	1,301,077,803	1,185,442,210
純資産合計	1,301,077,803	1,185,442,210
負債純資産合計	1,313,434,639	1,201,543,139

(2) 損益及び剰余金計算書

	第5期	第6期
	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	12,554,912	15,371,222
受取利息	4	29
有価証券売買等損益	122,135,063	△116,059,081
派生商品取引等損益	2,035,508	443,070
その他収益	8,073	3,185
営業収益合計	136,733,560	△100,241,575
営業費用		
支払利息	5,439	2,371
受託者報酬	184,830	192,988
委託者報酬	739,492	772,079
その他費用 ※1	403,843	413,623
営業費用合計	1,333,604	1,381,061
営業利益又は営業損失 (△)	135,399,956	△101,622,636
経常利益又は経常損失 (△)	135,399,956	△101,622,636
当期純利益又は当期純損失 (△)	135,399,956	△101,622,636
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△45,509,190	85,606,098
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,925,697	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	6,925,697	—
分配金 ※2	11,210,365	14,012,957
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	85,606,098	△30,029,495

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 6 期	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 5 期	第 6 期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	1,116,220,455 円	1,215,471,705 円
期中追加設定元本額	99,251,250 円	－円
期中一部交換元本額	－円	－円
2. 計算期間末日における受益権の総数	609,259 口	609,259 口

3. ※2 元本の欠損	—————	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は30,029,495円であります。
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 10,572,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 10,038,000円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第5期	第6期
	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
1. ※1 その他費用	主に、分配金の支払い事務にかかる諸費用であります。	主に、分配金の支払い事務にかかる諸費用であります。
2. ※2 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（12,557,550円）及び分配準備積立金（28,345円）の合計額から、経費（1,328,165円）を控除して計算される分配対象額は11,257,730円（100口当たり1,847円）であり、うち11,210,365円（100口当たり1,840円）を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（15,372,065円）及び分配準備積立金（47,365円）の合計額から、経費（1,378,690円）を控除して計算される分配対象額は14,040,740円（100口当たり2,304円）であり、うち14,012,957円（100口当たり2,300円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期
	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

<p>2. 金融商品の内容及びリスク</p>	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

<p>区 分</p>	<p>第6期 2020年7月10日現在</p>
<p>1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額</p>	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 金融商品の時価の算定方法</p>	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第 5 期 2020年1月10日現在	第 6 期 2020年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	108,574,468	△97,456,258
合計	108,574,468	△97,456,258

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第 5 期 2020年1月10日 現在				第 6 期 2020年7月10日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	6,134,000	—	6,192,000	58,000	7,175,500	—	6,952,500	△223,000
合計	6,134,000	—	6,192,000	58,000	7,175,500	—	6,952,500	△223,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

第6期 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第5期 2020年1月10日現在	第6期 2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	2,135.51円	1,945.71円
（100口当たり純資産額）	（213,551円）	（194,571円）

2020年7月期（2020年1月11日～2020年7月10日）決算短信

2020年8月21日

ファンド名 ダイワ上場投信－MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数 上場取引所 東証
 コード番号 1653
 連動対象指標 MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数
 主要投資資産 株式、投資証券
 売買単位 10口
 管理会社 大和アセットマネジメント株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 問合せ先責任者 (役職名)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

有価証券報告書提出予定日 2020年10月 2日
 分配金支払開始日 2020年 8月18日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月期の運用状況（2020年1月11日～2020年7月10日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2020年 7月期	4,642	(99.4)	25	(0.6)	4,668	(100.0)
2020年 1月期	6,005	(99.5)	29	(0.5)	6,034	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年 7月期	2,791	831	1,241	2,382
2020年 1月期	1,833	1,006	47	2,791

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×10
	百万円	百万円	百万円	円
2020年 7月期	4,727	58	4,668	19,596.1
2020年 1月期	6,082	48	6,034	21,615.0

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2020年 7月期	213
2020年 1月期	156

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

II 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第5期	第6期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	59,962,811	77,013,685
株式 ※3	5,916,072,930	4,583,882,430
投資証券	88,996,200	58,628,300
派生商品評価勘定	215,850	—
未収入金	11,379,380	—
未収配当金	6,186,467	4,593,850
前払金	—	3,050,000
流動資産合計	6,082,813,638	4,727,168,265
資産合計	6,082,813,638	4,727,168,265
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,440	1,165,590
前受金	434,000	—
未払金	—	2,725,920
未払収益分配金	43,554,295	50,742,414
未払受託者報酬	734,704	778,543
未払委託者報酬	2,938,953	3,114,280
その他未払費用	355,176	323,553
流動負債合計	48,025,568	58,850,300
負債合計	48,025,568	58,850,300
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	5,483,374,088	4,678,784,172
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	551,413,982	△10,466,207
（分配準備積立金）	63,757	89,046
元本等合計	6,034,788,070	4,668,317,965
純資産合計	6,034,788,070	4,668,317,965
負債純資産合計	6,082,813,638	4,727,168,265

(2) 損益及び剰余金計算書

	第5期	第6期
	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
	金額（円）	金額（円）
営業収益		
受取配当金	47,998,785	55,471,786
受取利息	17	110
有価証券売買等損益	541,657,365	△533,257,047
派生商品取引等損益	4,774,012	971,240
その他収益	13,711	19,059
営業収益合計	594,443,890	△476,794,852
営業費用		
支払利息	9,385	9,400
受託者報酬	734,704	778,543
委託者報酬	2,938,953	3,114,280
その他費用 ※1	787,857	821,029
営業費用合計	4,470,899	4,723,252
営業利益又は営業損失（△）	589,972,991	△481,518,104
経常利益又は経常損失（△）	589,972,991	△481,518,104
当期純利益又は当期純損失（△）	589,972,991	△481,518,104
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△80,657,993	551,413,982
剰余金増加額又は欠損金減少額	85,653,279	63,220,123
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	1,498,678	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	84,154,601	63,220,123
剰余金減少額又は欠損金増加額	—	92,839,794
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	92,839,794
分配金 ※2	43,554,295	50,742,414
期末剰余金又は期末欠損金（△）	551,413,982	△10,466,207

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 6 期 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	第 5 期 2020年1月10日現在	第 6 期 2020年7月10日現在
1. ※1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部交換元本額	3,600,383,196 円 1,976,373,200 円 93,382,308 円	5,483,374,088 円 1,632,889,240 円 2,437,479,156 円
2. 計算期間末日における受益 権の総数	2,791,942 口	2,382,273 口
3. ※2 元本の欠損	—————	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その差 額は10,466,207円であります。
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証 券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 12,072,000 円	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 8,940,000 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第 5 期 自 2019年7月11日 至 2020年1月10日	第 6 期 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
1. ※1 その他費用	主に、対象指数の商標の使用料 及び分配金の支払い事務にか かる諸費用であります。	主に、対象指数の商標の使用料 及び分配金の支払い事務にか かる諸費用であります。
2. ※2 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取 配当金、配当株式、受取利息及 びその他収益金から支払利息 を控除した当期配当等収益額 （48,003,128 円）及び分配準 備積立金（76,438 円）の合計額 から、経費（4,461,514 円）を控 除して計算される分配対象額 は 43,618,052 円（100 口当 たり 1,562 円）であり、うち	当計算期間中に計上した受取 配当金、配当株式、受取利息及 びその他収益金から支払利息 を控除した当期配当等収益額 （55,481,555 円）及び分配準 備積立金（63,757 円）の合計額 から、経費（4,713,852 円）を控 除して計算される分配対象額 は 50,831,460 円（100 口当 たり 2,133 円）であり、うち

	43,554,295 円（100 口当たり 1,560 円）を分配金額としてお ります。	50,742,414 円（100 口当たり 2,130 円）を分配金額としてお ります。
--	--	--

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 6 期	
	自 2020 年 1 月 11 日 至 2020 年 7 月 10 日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。	
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 6 期 2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第 5 期 2020年1月10日現在	第 6 期 2020年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	515,301,929	△343,129,861
投資証券	3,977,293	△12,314,727
合計	519,279,222	△355,444,588

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第 5 期 2020年1月10日 現在				第 6 期 2020年7月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	29,202,500	—	29,412,000	209,500	27,583,000	—	26,419,500	△1,163,500
合計	29,202,500	—	29,412,000	209,500	27,583,000	—	26,419,500	△1,163,500

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

第 6 期	
自 2020年1月11日	
至 2020年7月10日	
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	

（1口当たり情報）

	第 5 期	第 6 期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	2,161.50円	1,959.61円
（100口当たり純資産額）	（216,150円）	（195,961円）

2020年7月期（2020年1月11日～2020年7月10日）決算短信

2020年8月21日

ファンド名 ダイワ上場投信－FTSE Blossom Japan Index 上場取引所 東証
 コード番号 1654
 連動対象指標 FTSE Blossom Japan Index
 主要投資資産 株式
 売買単位 10口
 管理会社 大和アセットマネジメント株式会社 URL <https://www.daiwa-am.co.jp/>
 代表者名 (役職名)代表取締役社長 (氏名)松下 浩一
 問合せ先責任者 (役職名)営業企画部 (氏名)岩崎 論 TEL (03)5555-4821

有価証券報告書提出予定日 2020年10月 2日
 分配金支払開始日 2020年 8月18日

I ファンドの運用状況

1. 2020年7月期の運用状況（2020年1月11日～2020年7月10日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2020年 7月期	1,747	(98.3)	30	(1.7)	1,777	(100.0)
2020年 1月期	2,223	(99.1)	19	(0.9)	2,242	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2020年 7月期	1,712	79	237	1,554
2020年 1月期	1,945	—	232	1,712

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×10)
	百万円	百万円	百万円	円
2020年 7月期	1,806	28	1,777	11,437.2
2020年 1月期	2,270	27	2,242	13,096.1

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2020年 7月期	157
2020年 1月期	146

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

Ⅱ 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	第5期	第6期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	38,800,331	54,057,365
株式 ※3	2,223,773,950	1,747,312,270
派生商品評価勘定	143,680	—
未収入金	3,840,320	—
未収配当金	3,601,950	3,108,750
前払金	—	2,101,800
流動資産合計	2,270,160,231	1,806,580,185
資産合計	2,270,160,231	1,806,580,185
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	1,427,920
前受金	289,000	—
未払金	—	1,235,540
未払収益分配金	25,005,536	24,403,813
未払受託者報酬	350,678	313,370
未払委託者報酬	1,402,860	1,253,590
その他未払費用	125,696	162,800
流動負債合計	27,173,770	28,797,033
負債合計	27,173,770	28,797,033
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	2,140,885,000	1,942,978,750
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	102,101,461	△165,195,598
(分配準備積立金)	133,162	52,635
元本等合計	2,242,986,461	1,777,783,152
純資産合計	2,242,986,461	1,777,783,152
負債純資産合計	2,270,160,231	1,806,580,185

(2) 損益及び剰余金計算書

	第5期	第6期
	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	27,067,100	26,082,854
受取利息	127	542
有価証券売買等損益	228,490,704	△288,552,594
派生商品取引等損益	3,318,948	1,047,700
その他収益	7,412	3,807
営業収益合計	258,884,291	△261,417,691
営業費用		
支払利息	6,841	6,403
受託者報酬	350,678	313,370
委託者報酬	1,402,860	1,253,590
その他費用	202,369	190,554
営業費用合計	1,962,748	1,763,917
営業利益又は営業損失 (△)	256,921,543	△263,181,608
経常利益又は経常損失 (△)	256,921,543	△263,181,608
当期純利益又は当期純損失 (△)	256,921,543	△263,181,608
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△145,916,686	102,101,461
剰余金増加額又は欠損金減少額	16,102,140	20,288,362
当期一部交換に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	16,102,140	18,010,760
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	2,277,602
分配金 ※1	25,005,536	24,403,813
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	102,101,461	△165,195,598

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 6 期	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 5 期	第 6 期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. ※1 期首元本額	2,431,667,500 円	2,140,885,000 円
期中追加設定元本額	－円	99,512,500 円
期中一部交換元本額	290,782,500 円	297,418,750 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,712,708 口	1,554,383 口

3. ※2 元本の欠損	—————	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は165,195,598円であります。
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 7,487,600円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 5,990,800円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
※1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(27,067,798円)及び分配準備積立金(26,807円)の合計額から、経費(1,955,907円)を控除して計算される分配対象額は25,138,698円(100口当たり1,467円)であり、うち25,005,536円(100口当たり1,460円)を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(26,080,800円)及び分配準備積立金(133,162円)の合計額から、経費(1,757,514円)を控除して計算される分配対象額は24,456,448円(100口当たり1,573円)であり、うち24,403,813円(100口当たり1,570円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期
	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

<p>2. 金融商品の内容及びリスク</p>	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 6 期 2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 5 期 2020年1月10日現在	第 6 期 2020年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	220,469,301	△245,185,035
合計	220,469,301	△245,185,035

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第 5 期 2020年1月10日 現在				第 6 期 2020年7月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	18,431,000	—	18,576,000	145,000	32,016,500	—	30,591,000	△1,425,500
合計	18,431,000	—	18,576,000	145,000	32,016,500	—	30,591,000	△1,425,500

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 6 期	
自 2020年1月11日	
至 2020年7月10日	
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	

(1口当たり情報)

	第 5 期	第 6 期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	1,309.61円	1,143.72円
(100口当たり純資産額)	(130,961円)	(114,372円)